

工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信纯债定期开放债券
场内简称	工银纯债
交易代码	164010
基金运作方式	上证契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年6月21日
报告期末基金份额总额	399,224,242.04份
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期应计利息收入	13,777,636.09
2.本期利润	4,657,473.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0117
4.期末基金份额净值	432,894,996.32
5.期末基金份额净值	1.084

注:1.本基金基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,费用计算后实际收益水平要低于所列数字。

2. "本期利润"指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额; "本期利润"为本期应计利息收入加上本期公允价值变动收益。

3. 所列数据截止到2015年12月31日。

§ 2.1 基金净值表现

本基金报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.12% 0.12% 1.01% 0.01% 0.11% 0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金报告期末未持有股指期货投资。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
杜海涛	投资总监、固定收益总监、本基金的基金经理	2012年6月21日	18	先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理,2006年加入鹏华基金管理有限公司担任基金经理助理,2008年加入人保信托投资有限公司担任基金经理助理,2010年6月16日至2012年6月16日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2012年6月16日至2013年1月15日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2013年1月15日至2013年11月15日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2013年11月15日至2014年1月15日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2014年1月15日至2014年11月15日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2014年11月15日至2015年1月15日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2015年1月15日至2015年6月16日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2015年6月16日至2015年12月31日,担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理。
范冰	固定收益总监、本基金的基金经理	2015年4月17日	9	先后在中国银行总行风险管理部,在光大保德信基金管理有限公司担任固定收益总监,2010年1月加入鹏华基金管理有限公司,担任基金经理助理,2010年1月11日至2011年1月10日,担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2011年1月11日至2011年1月10日,担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2011年1月11日至2013年3月29日,担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2013年3月29日至2015年1月15日,担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2015年1月15日至2015年1月16日,担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2015年1月16日至2015年4月17日,担任鹏华基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,招募说明书等有关基金法律文件的规定,依法诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

为了公平对各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理办法》、《公平交易制度指导意见》等法律法规及公司内部规章制度,拟定了《公平交易管理办法》。《公平交易管理办法》对公司的各类资产的公平对待做了具体的规定,并规定对买卖股票、债券时的市场价格和交易时机进行公平的决策,对证券同时买卖的股票的买卖时机进行公平的决策,本报告期内,根据投资组合的股票投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面,第四季度我国经济继续延续下滑态势,物价低位震荡。在经济疲弱的情况下,央行实行了宽松的货币政策,但全面降息和降准的预期较低,世界经济仍处于金融危机后的深度调整期。主要经济体

了宽松的货币政策,但全面降息和降准的预期较低,世界经济仍处于金融危机后的深度调整期。主要经济体

了宽松的货币政策,但全面降息和降准的预期较低,世界经济仍处于金融危机后的深度调整